

2024

Relatório Mensal

Agosto

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
TÍTULOS PÚBLICOS	219.799.568,24	36,23%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.026.689,87	5,77%	6.458.247.673,10	0,54%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.909.934,75	2,79%	4.604.965.566,98	0,37%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	66.955.425,50	11,04%	8.028.368.624,38	0,83%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.434.422,45	2,54%	1.868.959.978,30	0,83%	7º I b
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.031.589,06	0,17%	15.057.333.281,43	0,01%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	78.630.950,49	12,96%	18.688.563.354,91	0,42%	7º III a
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	27.041.446,05	4,46%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	28.286.524,39	4,66%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	38.528.889,87	6,35%	0,00		7º IV
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	22.142.326,18	3,65%	0,00		7º IV
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	27.180.567,50	4,48%	1.149.370.153,49	2,36%	8º I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	17.713.818,78	2,92%	478.571.922,90	3,70%	8º I
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.966.760,70	1,97%	764.869.925,79	1,56%	9º III

Investimentos

 606.648.913,83

Disponibilidades Financeiras

 0,00

Total Carteira

 606.648.913,83

Governança (Pró Gestão)



Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2040 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	5.000	4.401,989593	22.009.947,96
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	3.000	4.362,013133	13.086.039,40
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	2.000	4.362,013133	8.724.026,27
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	1.000	4.448,849617	4.448.849,62
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	14/09/2022	Curva - Taxa: 5,9000%	2.672	4.402,706002	11.764.030,44
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7650%	7.828	4.479,875286	35.068.463,74
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/04/2022	A mercado	1.174	4.274,348031	5.018.084,59
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	2.000	4.460,243103	8.920.486,21
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/11/2022	Curva - Taxa: 6,0100%	8.326	4.406,59446	36.689.305,47
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	04/05/2022	Curva - Taxa: 5,8501%	46	4.444,348328	204.440,02
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2022	Curva - Taxa: 5,7699%	4.500	4.496,654783	20.234.946,52
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 5,8625%	5.000	4.436,351309	22.181.756,54
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,1450%	2.300	4.260,378065	9.798.869,55
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7555%	154	4.506,15367	693.947,67
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2024	A mercado	5.000	4.191,274850	20.956.374,25

Investimentos

\$ 606.648.913,83

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 606.648.913,83

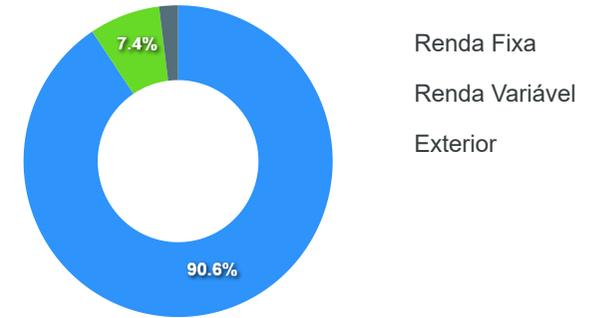
Governança (Pró Gestão)


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	36,23% 219.799.568,24	63,77% 386.849.345,59
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	22,14% 134.326.472,57	77,86% 472.322.441,26
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	13,13% 79.662.539,55	46,87% 284.326.808,75
7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	19,12% 115.999.186,49	0,88% 5.330.596,28
8º I - Fundos de Ações	30,00%	7,40% 44.894.386,28	22,60% 137.100.287,87
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,97% 11.966.760,70	8,03% 48.698.130,68

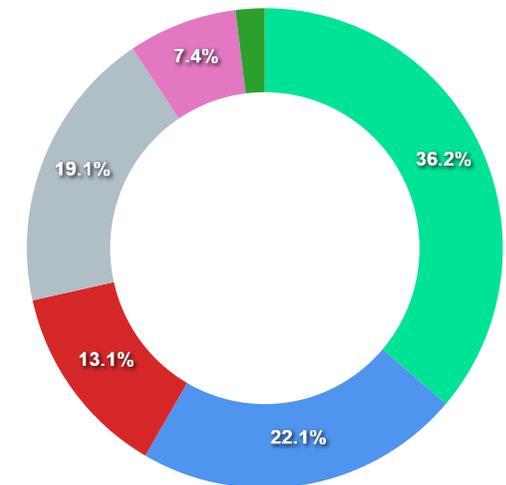
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos

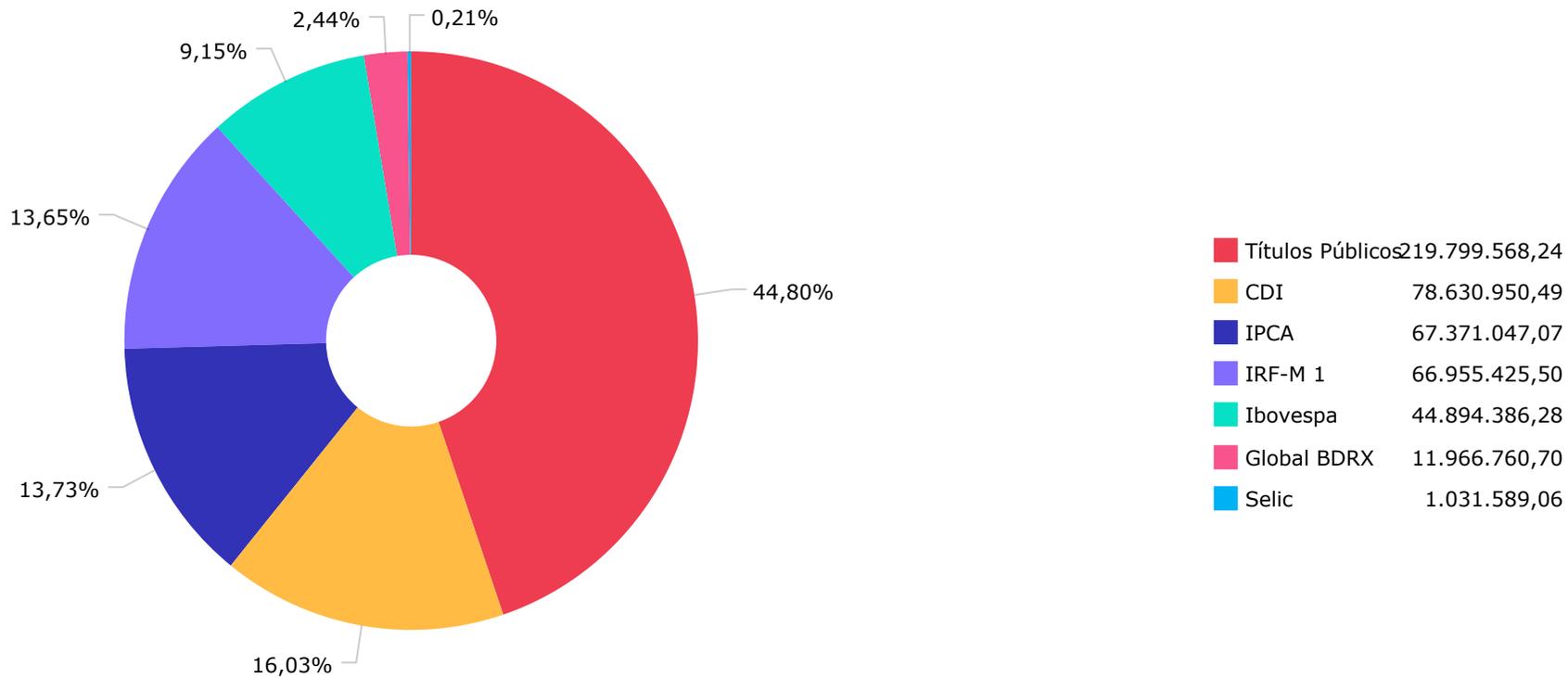


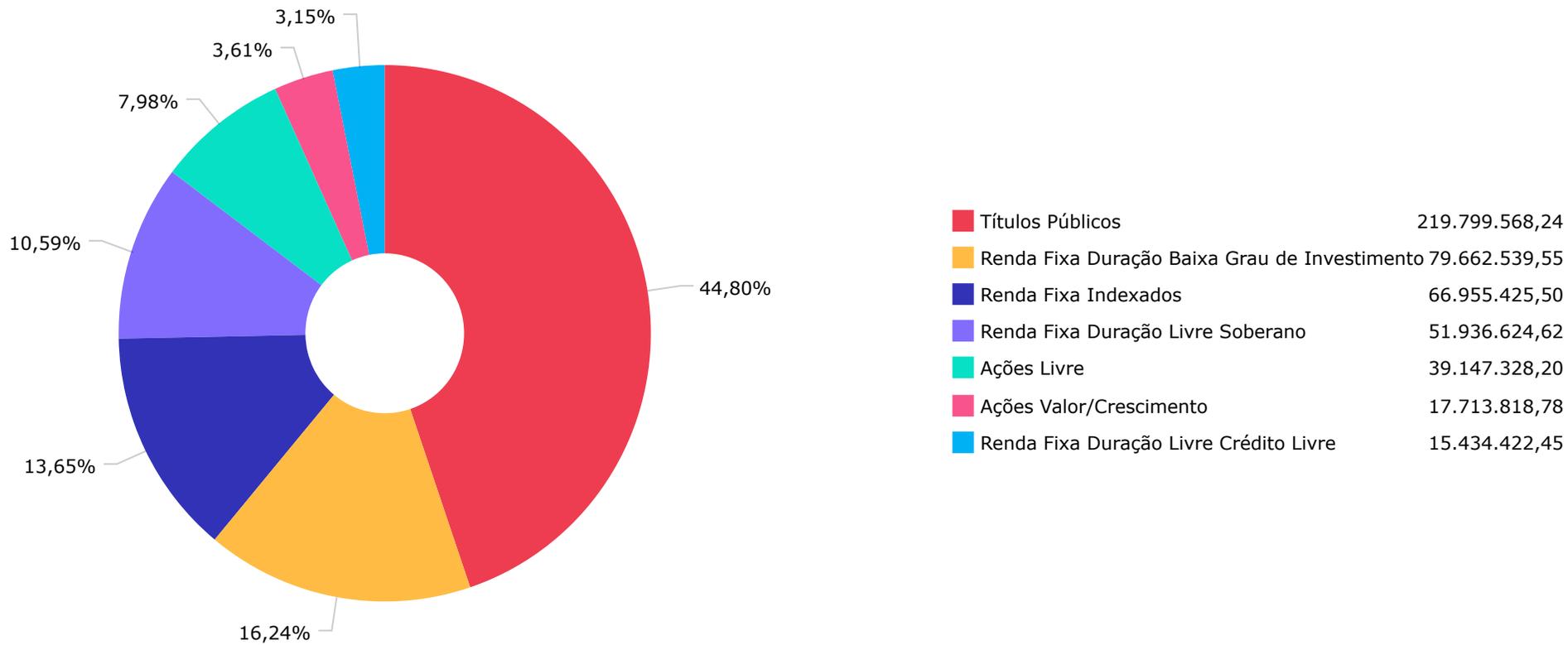
Artigos

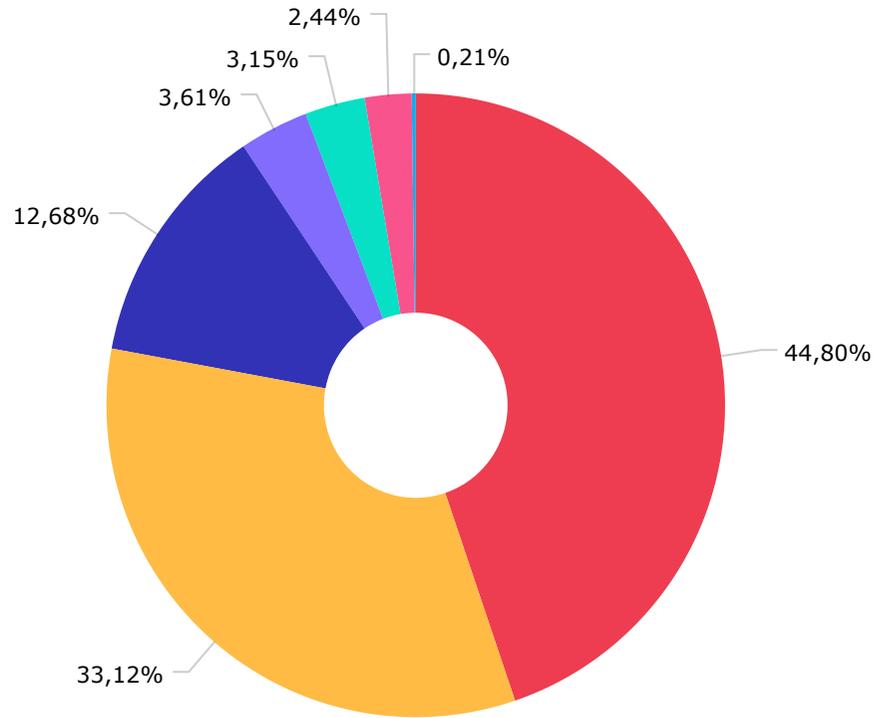


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	36,23%	0,00%	36,00%	100,00%	386.849.345,59	8° I - Fundos de Ações	7,40%	0,00%	6,00%	30,00%	137.100.287,87
7° I b - FI 100% Títulos TN	22,14%	0,00%	14,00%	100,00%	472.322.441,26	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	6,00%	30,00%	181.994.674,15
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	606.648.913,83	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	60.664.891,38
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	30.332.445,69	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	60.664.891,38
7° III a - FI Referenciados RF	13,13%	0,00%	15,00%	60,00%	284.326.808,75	9° III - Ações - BDR Nível I	1,97%	0,00%	2,00%	10,00%	48.698.130,68
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	363.989.348,30	10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	60.664.891,38
7° IV - Ativos Financeiros de ...	19,12%	0,00%	14,00%	20,00%	5.330.596,28	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	30.332.445,69
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	30.332.445,69						
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	30.332.445,69						
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	30.332.445,69						

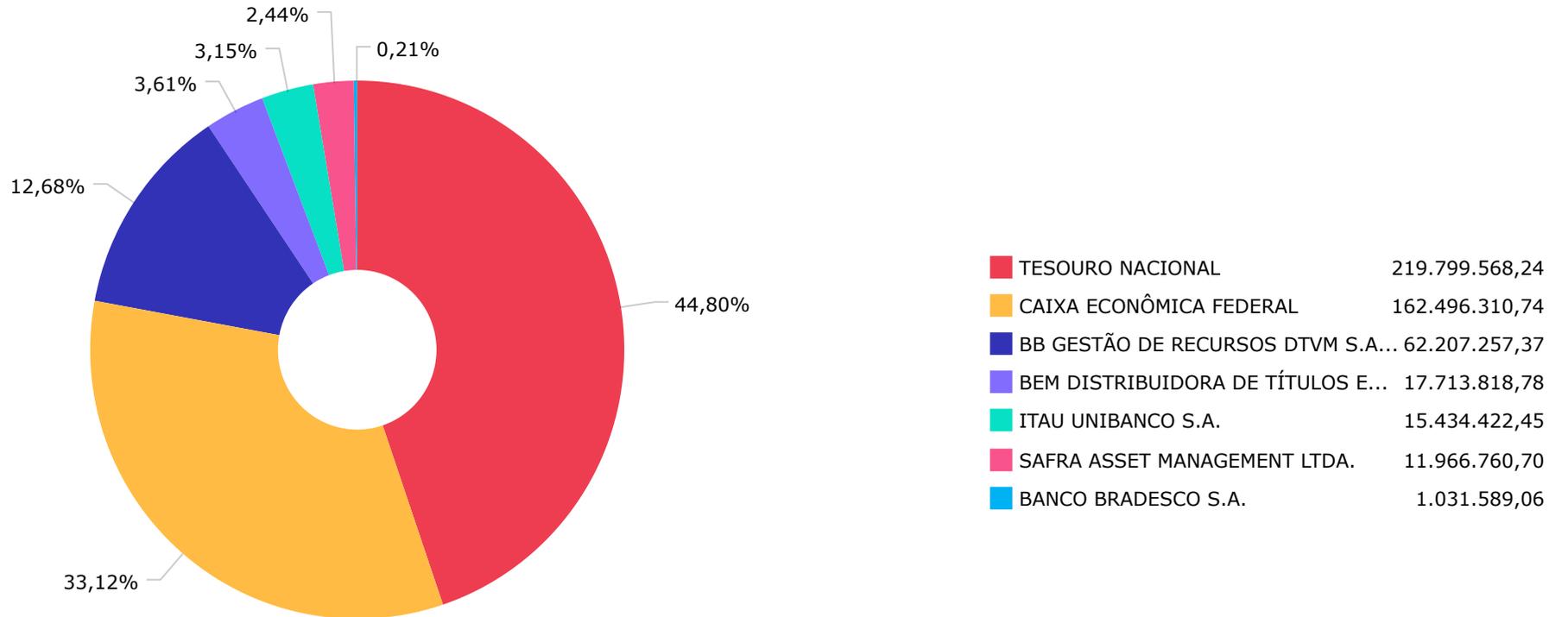
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,88	7,33	2,70	5,39	11,61	26,97	0,02	0,05
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	0,55	42,25	13,74	27,72	48,00	71,14		
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,16	31,65	13,54	22,58	36,50	49,59	9,09	19,14
IBOVESPA - BENCHMARK	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18		
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	6,42	0,65	9,33	3,50	15,75	24,86	6,39	13,45
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	4,68	-4,65	9,30	1,39	9,11	10,30	5,93	12,49
IPCA - BENCHMARK	-0,02	2,85	0,57	1,58	4,24	9,04		
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95	5,91	2,38	4,21	9,96	25,37	0,41	0,86
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,68	4,05	1,82	2,80	7,52	22,31	0,64	1,35
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,70	3,53	1,38	2,47	7,38	21,12	0,69	1,46
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,77	6,30	2,36	4,62	10,39	25,57		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,75	6,24	2,30	4,51	10,24	25,14	0,30	0,64
SELIC - BENCHMARK	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91	7,71	2,77	5,61	12,12	27,88	0,04	0,08







TESOURO NACIONAL	219.799.568,24
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	162.496.310,74
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	62.207.257,37
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	17.713.818,78
ITAU UNIBANCO S.A.	15.434.422,45
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	11.966.760,70
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	1.031.589,06



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	555.471.939,62	3.459.435,67	6.976.737,86	555.888.364,94	3.933.727,51	3.933.727,51	0,71% ▲	0,71%	0,84%	0,84%	84,52%	0,61%
Fevereiro	555.888.364,94	13.121.177,93	9.022.822,62	565.782.661,55	5.795.941,30	9.729.668,81	1,04% ▲	1,75%	1,20%	2,05%	85,37%	0,71%
Março	565.782.661,55	29.232.887,35	30.527.818,89	570.083.126,57	5.595.396,56	15.325.065,37	0,99% ▲	2,76%	0,54%	2,60%	106,15%	0,54%
Abril	570.083.126,57	4.342.199,84	3.640.748,99	572.319.389,76	1.534.812,34	16.859.877,71	0,27% ▲	3,03%	0,80%	3,42%	88,60%	0,76%
Mai	572.319.389,76	52.454.006,19	63.085.696,36	565.735.296,16	4.047.596,57	20.907.474,28	0,71% ▲	3,76%	0,86%	4,31%	87,24%	0,58%
Junho	565.735.296,16	45.767.999,47	36.867.852,06	578.590.817,73	3.955.374,16	24.862.848,44	0,69% ▲	4,48%	0,59%	4,93%	90,87%	0,56%
Julho	578.590.817,73	15.262.466,15	5.557.260,60	595.285.843,34	6.989.820,06	31.852.668,50	1,19% ▲	5,72%	0,82%	5,79%	98,79%	0,62%
Agosto	595.285.843,34	33.594.208,52	29.375.349,62	606.648.913,83	7.144.211,59	38.996.880,09	1,19% ▲	6,98%	0,40%	6,21%	112,40%	0,73%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	15.325.065,37	2,76%	2,60%
2º Trim	9.537.783,07	1,67%	2,27%
1º Sem	24.862.848,44	4,48%	4,93%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

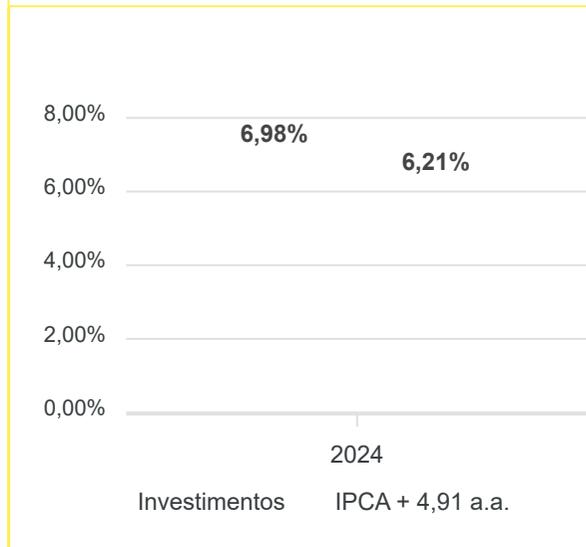
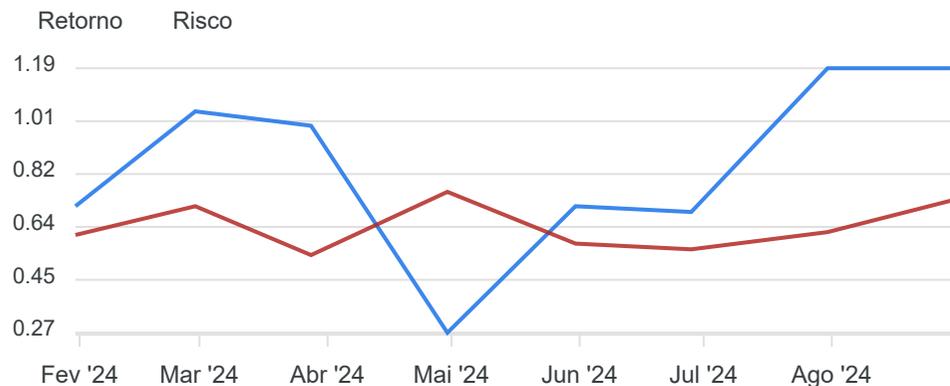
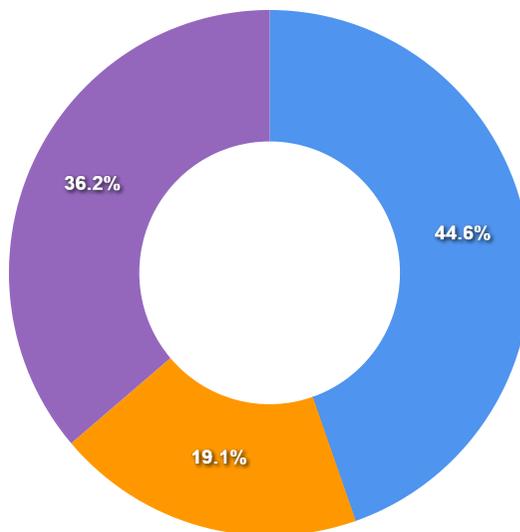


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 30/08/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	270.850.159,10	44,65
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	115.999.186,49	19,12
Acima D+3600	219.799.568,25	36,23
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	243.582.035,96	0,00	25.746.310,13	219.799.568,24	1.963.842,41	0,81% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.698.161,11	0,00	0,00	35.026.689,87	328.528,76	0,95% ▲	0,41%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.022.239,39	0,00	0,00	1.031.589,06	9.349,67	0,91% ▲	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	48.064.822,31	33.594.208,52	3.629.039,49	78.630.950,49	600.959,15	0,74% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.796.266,35	0,00	0,00	16.909.934,75	113.668,40	0,68% ▲	0,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	66.458.038,15	0,00	0,00	66.955.425,50	497.387,35	0,75% ▲	0,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.326.390,77	0,00	0,00	15.434.422,45	108.031,68	0,70% ▲	0,69%
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	26.833.383,27	0,00	0,00	27.041.446,05	208.062,78	0,78% ▲	-
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	28.041.376,09	0,00	0,00	28.286.524,39	245.148,30	0,87% ▲	-
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	38.173.065,47	0,00	0,00	38.528.889,87	355.824,40	0,93% ▲	-
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	21.966.292,68	0,00	0,00	22.142.326,18	176.033,50	0,80% ▲	-
	540.962.071,55	33.594.208,52	29.375.349,62	549.787.766,85	4.606.836,40	0,85%	0,13%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	25.965.688,18	0,00	0,00	27.180.567,50	1.214.879,32	4,68% ▲	5,93%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	16.644.909,92	0,00	0,00	17.713.818,78	1.068.908,86	6,42% ▲	6,39%
-	42.610.598,10	0,00	0,00	44.894.386,28	2.283.788,18	5,36%	6,11%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.713.173,69	0,00	0,00	11.966.760,70	253.587,01	2,16% ▲	9,09%
	11.713.173,69	0,00	0,00	11.966.760,70	253.587,01	2,16%	0,00%

